

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成31年1月9日(水)

短期市場の推移

[億円] [%]

	12月28日	1月4日	1月7日	1月8日
加重平均金利	▲0.055	▲0.070	▲0.068	▲0.066
東京レポレート(ON)	▲0.098	▲0.094	▲0.087	▲0.083
無コール残	39,941	69,957	80,957	79,937
ON	18,986	40,732	49,562	47,117
その他	20,955	29,225	31,395	32,820
有コール残	25,052	34,124	29,835	32,687

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

1月10日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
9:30頃	【挨拶】黒田日銀総裁(支店長会議)	-	(米)新規失業保険申請件数[前週分]	
14:00	地域経済報告(1月)	-	(米)パウエルFRB議長の講演(ワシントン)	
15:00	コール市場残高(12月)	-	(米)クラリダFRB副議長の講演(NY)	

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.062	▲0.082
T/N	-	-	▲0.020	▲0.081
S/N	-	-	▲0.040	-
1W	▲0.020	0.000	▲0.011	▲0.094
2W	▲0.040	▲0.005	▲0.020	▲0.118
3W	-	-	-	▲0.122
1M	-	-	▲0.045	▲0.130
2M	-	-	-	-
3M	-	-	0.004	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.156
1Y	-	-	-	▲0.157

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.08%の出合から始まった。その後は主に▲0.086%~▲0.035%の水準で取引された。地銀業態を中心に調達意欲が昨日対比で強まり、同加重平均金利は前営業日対比+0.004%の▲0.062%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.085 ~ ▲0.075	▲0.075 ~ ▲0.065	▲0.085 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続き地銀業態を中心に調達意欲が強く、堅調な地合を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	1月9日	1月10日	1月11日
券	+3,800	+2,800	+2,000
財政	▲19,500	+1,200	▲5,000
過不足	▲15,700	+4,000	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入			+4,700
CP等買入	▲400	▲100	
ETF買入	+700		
国債補完供給	+100	+600	
当座預金増減	▲15,300	+9,200	▲3,000
当座預金残高	3,853,500	3,862,700	3,859,700
準備預金残高	3,401,200	主な需給要因	
積み終了先	3,400,900	国庫短期証券	
超過準備	3,400,900	発行・償還(6M)	
非準備預金残高	452,300	国債発行(30年)	
準備預金進捗率	99.9%		
平均	80.6%		
乖離率	19.3%		

1月9日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(1/10~)						
5~10年	4,300	14,153	4,313	0.013	0.013	52.7
物価連動	250	1,380	252	▲0.100	▲0.106	93.6
国債補完供給(1/9~1/10)						
	28,530	4	4	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
1月8日時点 5,005,800	今積期の所要準備額 3,123,800
	1月10日以降の残り所要積数 700
	平均 100

国庫短期証券入札予定

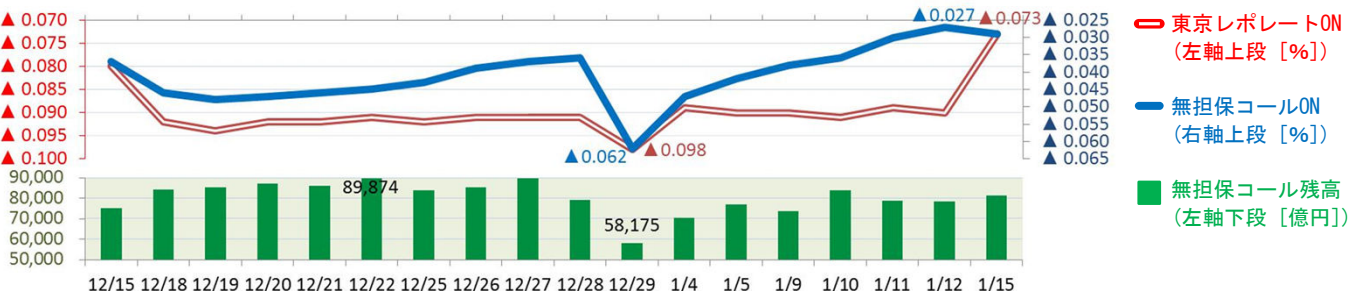
1月11日	3ヶ月	第807回
1月17日	1年	
1月18日	3ヶ月	
1月25日	3ヶ月	
1月10日	30年	
1月16日	5年	
1月24日	20年	
1月29日	40年	

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	12月19日	2
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	7	15 21 28	1月7日 3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,300	4	9 17 25 30	1月9日 3
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	2,000			
25年超	100~1,000 程度	500	7	15 21 28	1月7日 3
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	1月9日	1
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	12月17日	-

1年前の市場推移 ○2017年12月積み期 [12月15日~1月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。